

●資金需給

単位：億円	2026年9月9日 需給速報		2026年9月10日 需給予想		2026年9月11日 当社予想	
銀行券	600		100		500	
財政	▲ 35,900		2,200		▲ 11,100	
資金過不足	▲ 35,300		2,300		▲ 10,600	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,200			
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 400	500		400		
※下ろし資金供給用国債償還供給						
当預増減	▲ 35,200		9,900		▲ 10,600	
当座預金残高	4,116,600		4,126,500		4,115,900	
準備預金残高	3,811,200					
積み終了先	3,811,200				9月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,811,200				積数	
非準備預金先	305,400				1日平均	
積み期間（8/16～9/15日）の所要準備額（積数）					4,178,800	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	60.98%		

●2026年9月9日の市場動向

<無担保コール市場>

本日の無担保コールO/N物は、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られ、出会い水準は0.975~0.978%程度で推移した。ターム物では、引き続き月末越えの資金調達ニーズが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、1.005%程度の出合いとなった。
SCは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

<短国市場>

9日はTDB6M物(第1405回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーは堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で大型発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

9/9	無担保コール(速報)							短国		東京レポレート		JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替(ドル/円)	
単位: %	最低	最高	平均		最低	最高	平均	売買参考統計値		平均値		直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
O/N	0.950	1.030	0.977	1W	0.982	1.110	1.009		T+0	1.000	2.880	▲ 0.005	65,142.78	▲ 126.55	153.45-47	153.11-13	
T/N				2W			1.060		T+1	1.000							
S/N				3W			1.350										
2日				1M					1W	1.000							
3日				2M					2W	1.001							
4日				3M	1.410	1.420	1.417		3W	1.077							
5日				4M					1M	1.138							
6日	1.060	1.100	1.099	5M					3M	1.030	1.243						
有担保コール(速報)				6M				6M	1.285	1.334							
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.460	1.518							

日付		9/2	9/3	9/4	9/7	9/8
日銀当預残		4,155,500	4,157,400	4,158,300	4,161,200	4,151,800
準備預金残		3,834,400	3,838,300	3,845,300	3,844,200	3,835,800
マネタリーベース		5,349,400	5,351,000	5,351,100	5,353,400	5,343,200
無担O/N加重平均		0.977%	0.978%	0.977%	0.977%	0.977%
コール市場残高		127,646	126,234	125,402	129,231	127,935
うち無担	うちO/N	103,786	102,779	102,181	105,140	104,696
	うち有担	40,119	38,502	38,234	40,943	39,729
		23,860	23,455	23,221	24,091	23,239

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入決定額(億円)	募入最低価格	募入最高利回り・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回り・利回較差	第Ⅰ非償付競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1405	-	30,000	2026/9/10	2027/3/10	89,114	23,014.7	99.359	1.3009%	66.0709%	99.365	1.2887%	6,985	

●オペ結果

種類	オファー額 (億円・ 百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率 (%)	利回り (%)※1	応札総額 (億円・ 百万ドル)	落札総額 (億円・ 百万ドル)	按分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分 比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,550	2026/9/10				11,080	3,553	▲0.006		0.001	44.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,350	2026/9/10				7,862	3,354	▲0.006		▲0.005	67.9
国債買入(残存期間25年超)	750	2026/9/10				1,884	752	0.018		0.021	18.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/9/9	2026/9/10		0.500	454	454		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/9/9	2026/9/10		0.500	10	10		0.500	0.500	